공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	11	0	11	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

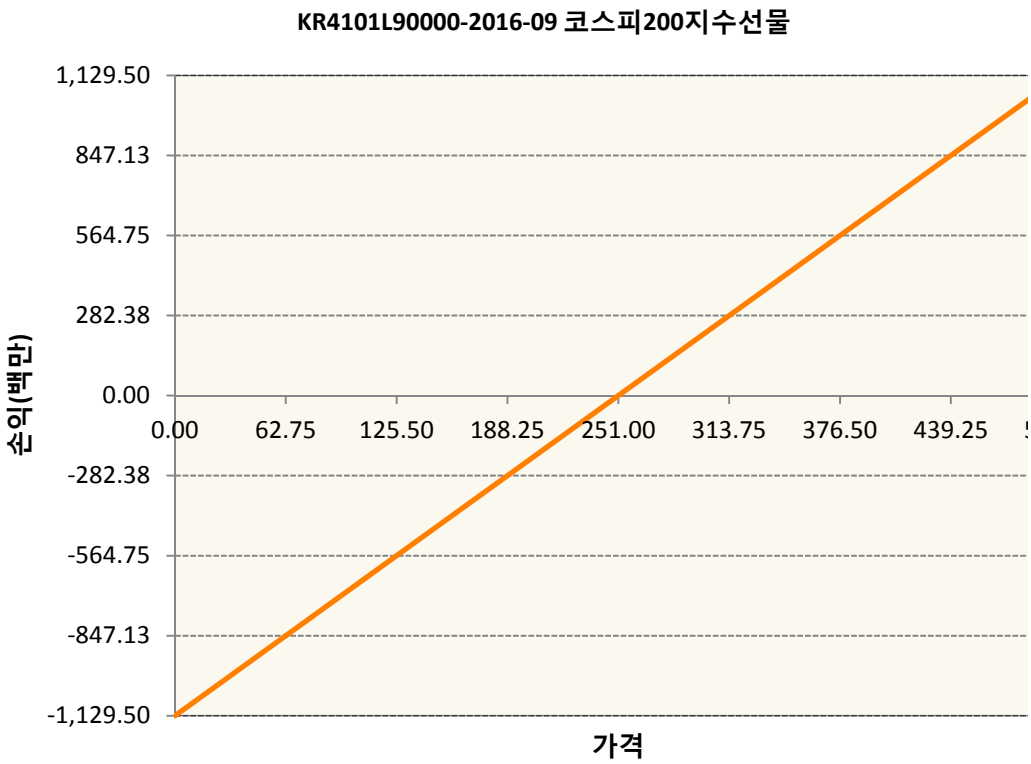
스마트인덱스모

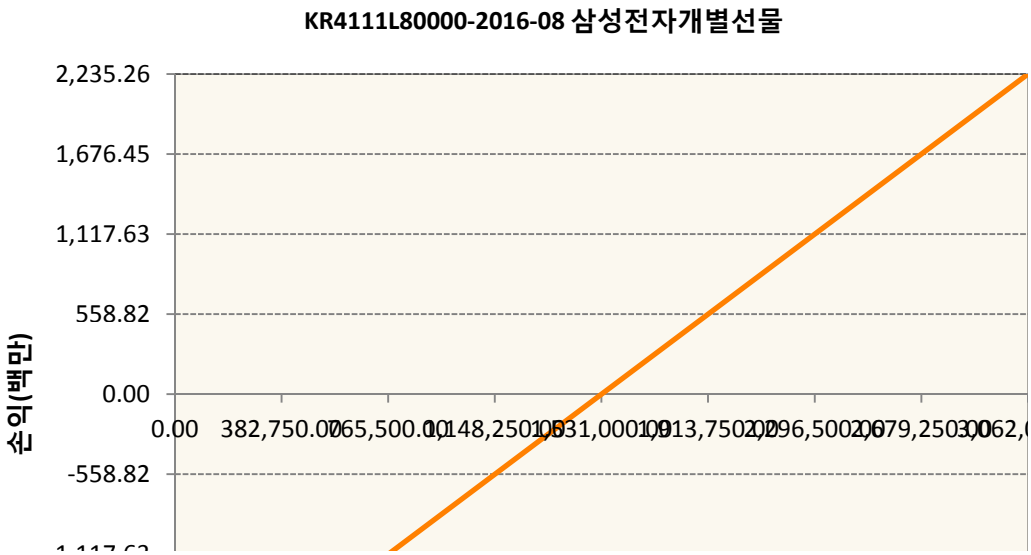
1. 계약금액

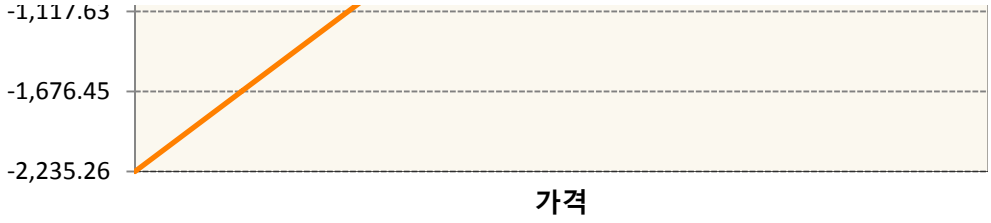
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	138	-138	장내
누계	유가증권	선물	3,365	0	3,365	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

KR4111L800	2016-08 삼성전자개별선물						179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	179	179	179	179	179	179	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

255

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

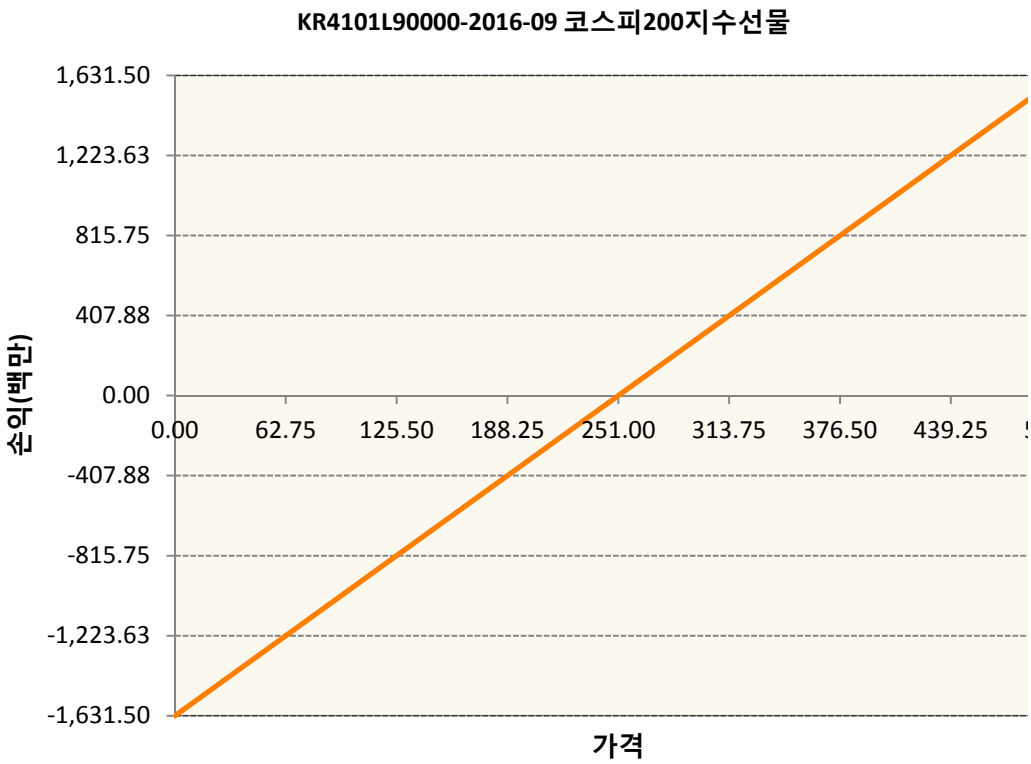
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,632	0	1,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

108

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

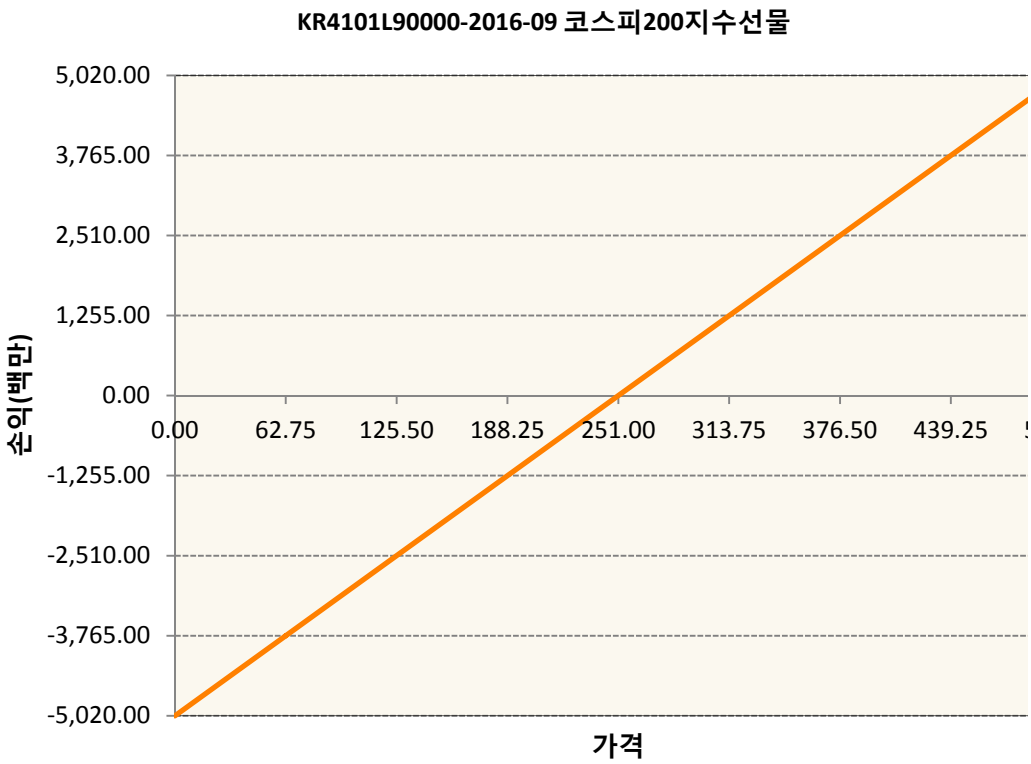
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	126	-126	장내
누계	유가증권	선물	5,020	0	5,020	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						402
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
-5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
-2.67%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	134	134	134	134	134	134	134
5.33%	268	268	268	268	268	268	268
8.00%	402	402	402	402	402	402	402

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

332

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

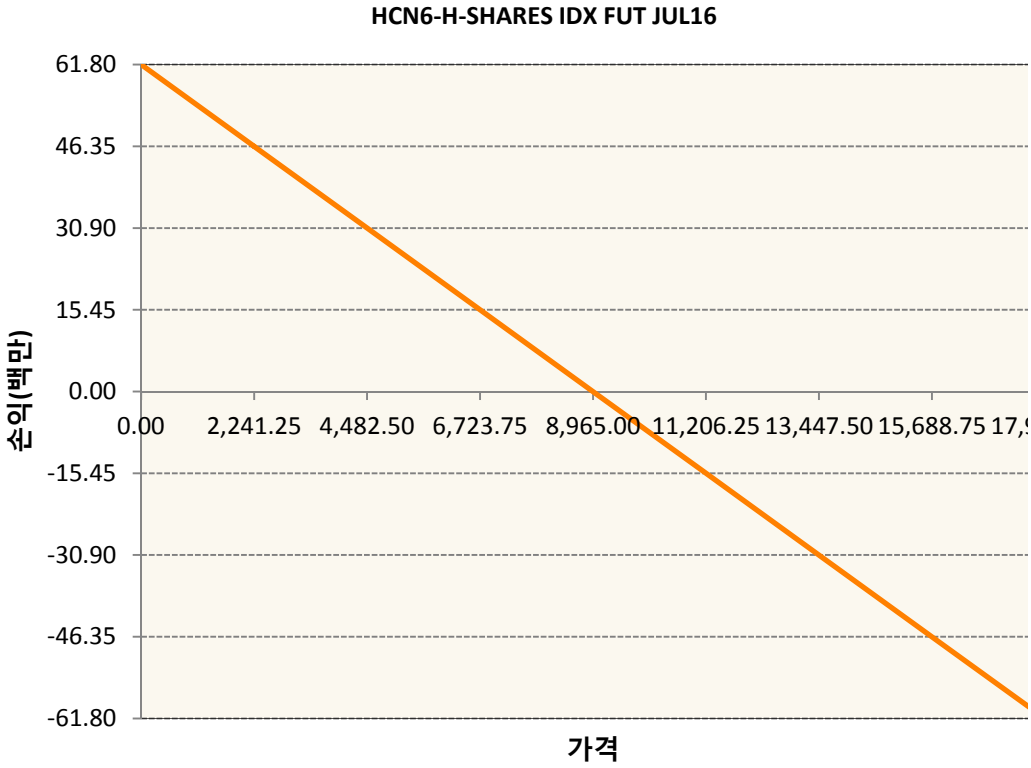
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

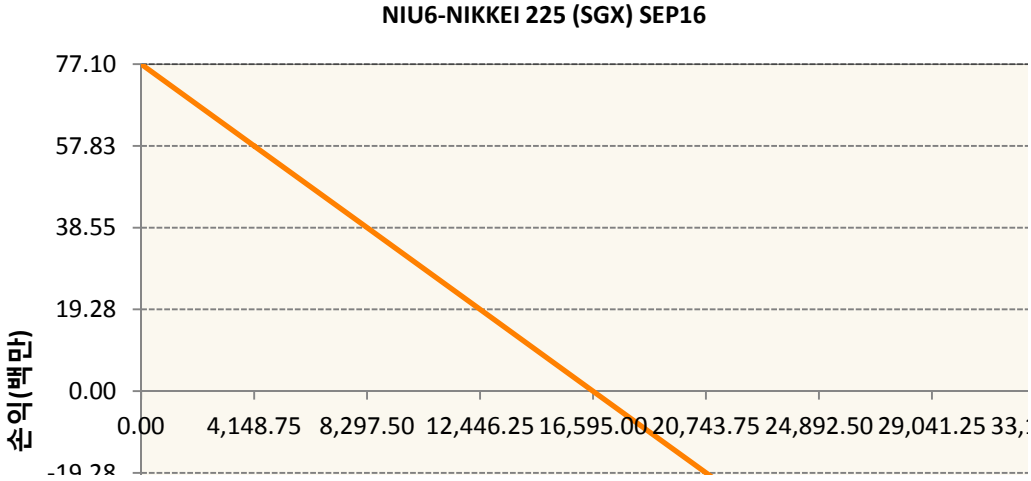
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	77	-77	
누계	유가증권	선물	0	62	-62	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	5
NIU6	NIKKEI 225 (SGX) SEP16	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	15

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	10,424	0	10,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160520	874

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

810

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,811	0	4,811	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160608	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,037

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

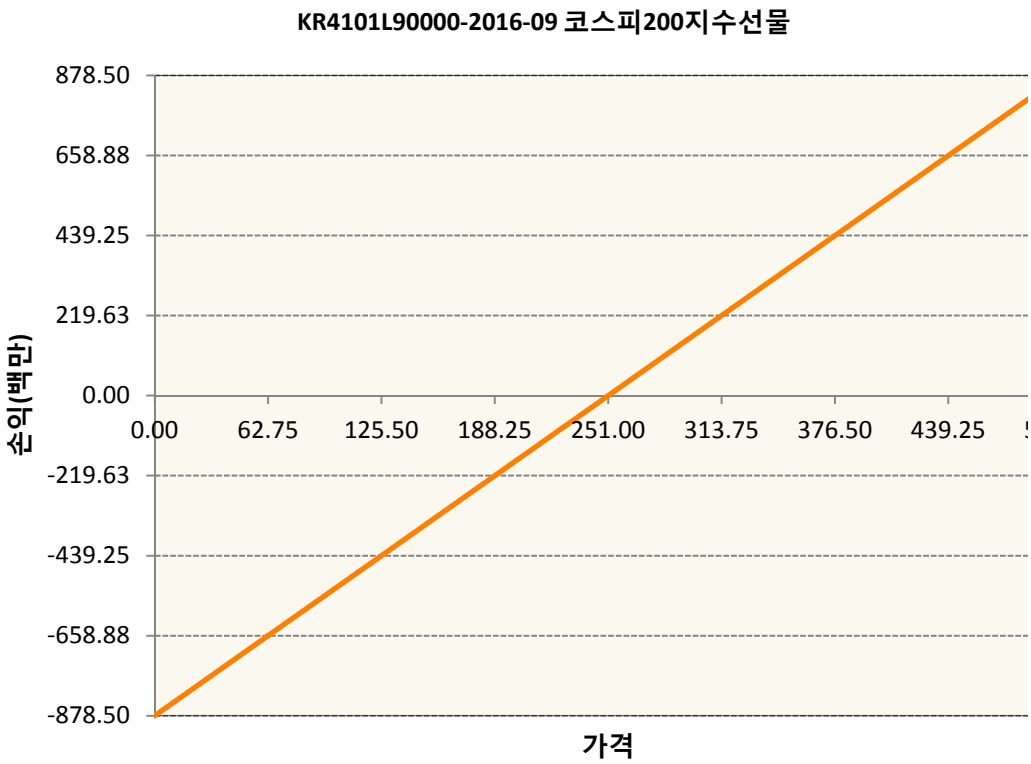
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	879	0	879	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

58

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

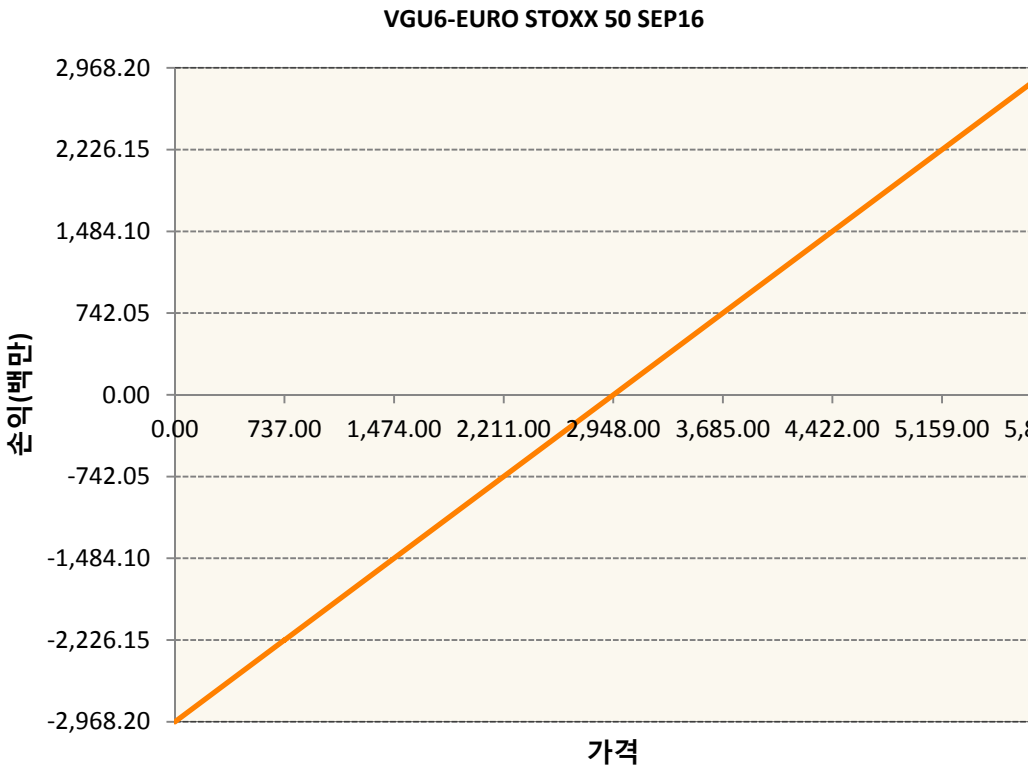
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,968	0	2,968	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	237

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

294

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

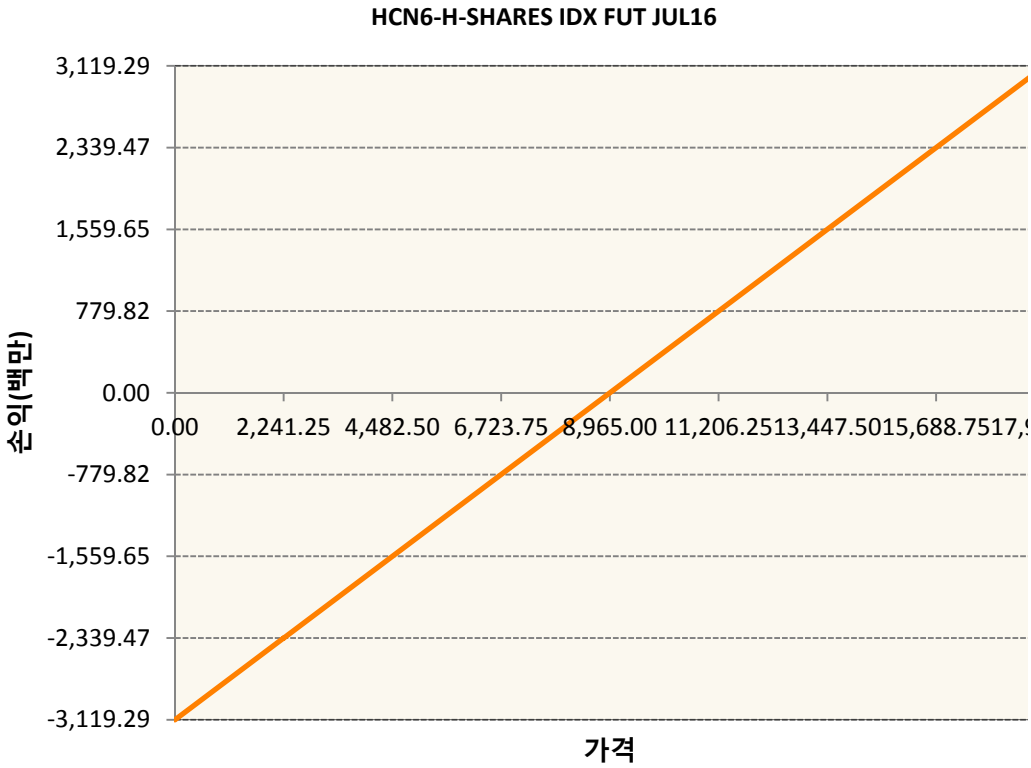
차이나인덱스모(주식-파생형)

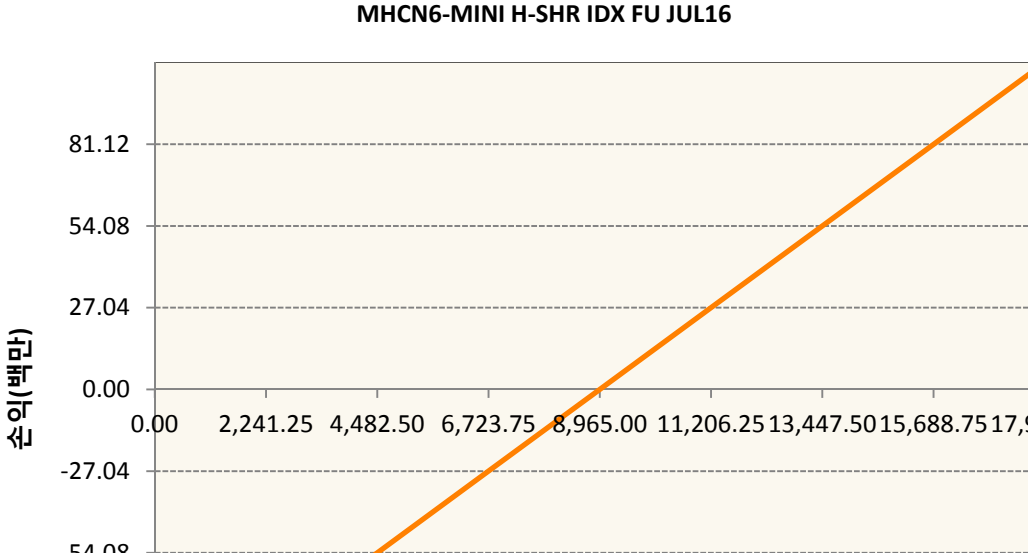
1. 계약금액

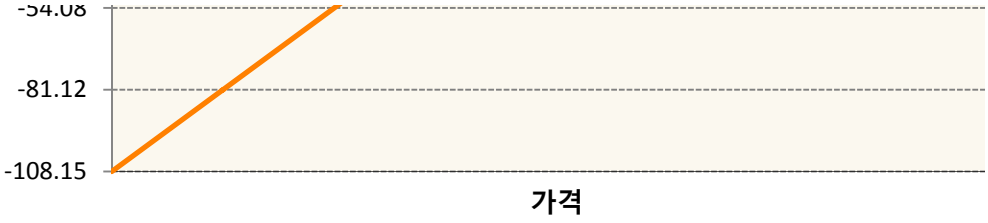
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,227	0	3,227	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	250
MHCN6	MINI H-SHR IDX FU JUL16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	362

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

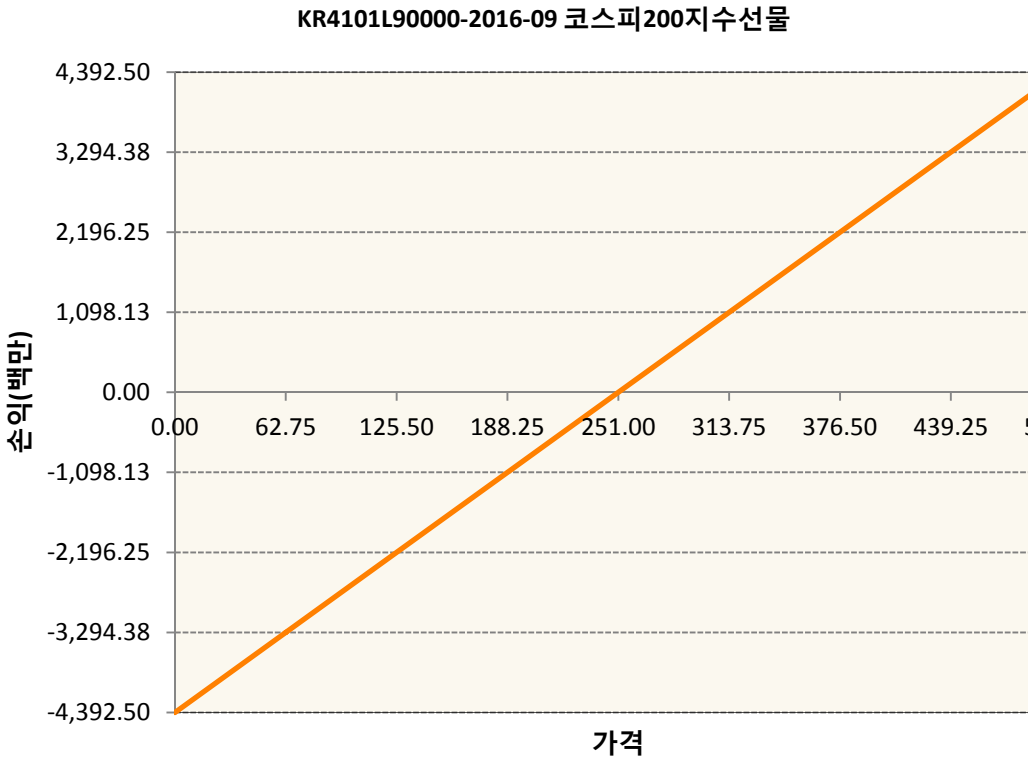
커버드콜(주식혼합-파생형)

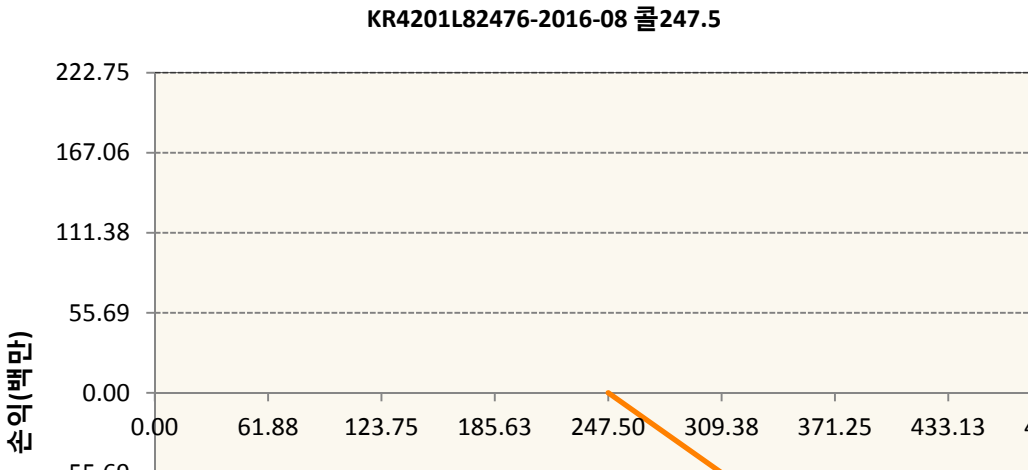
1. 계약금액

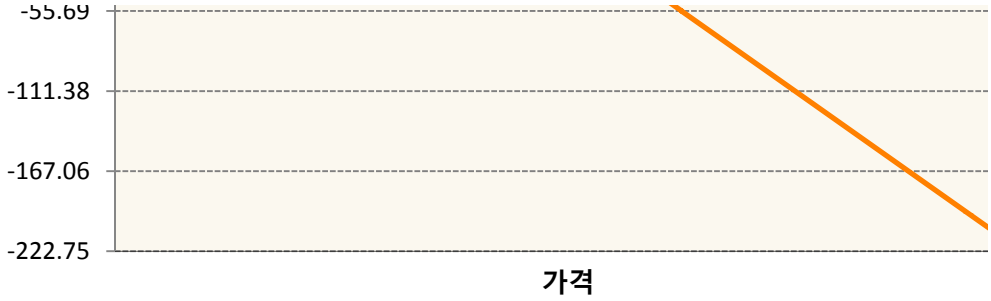
(단위:백만원)

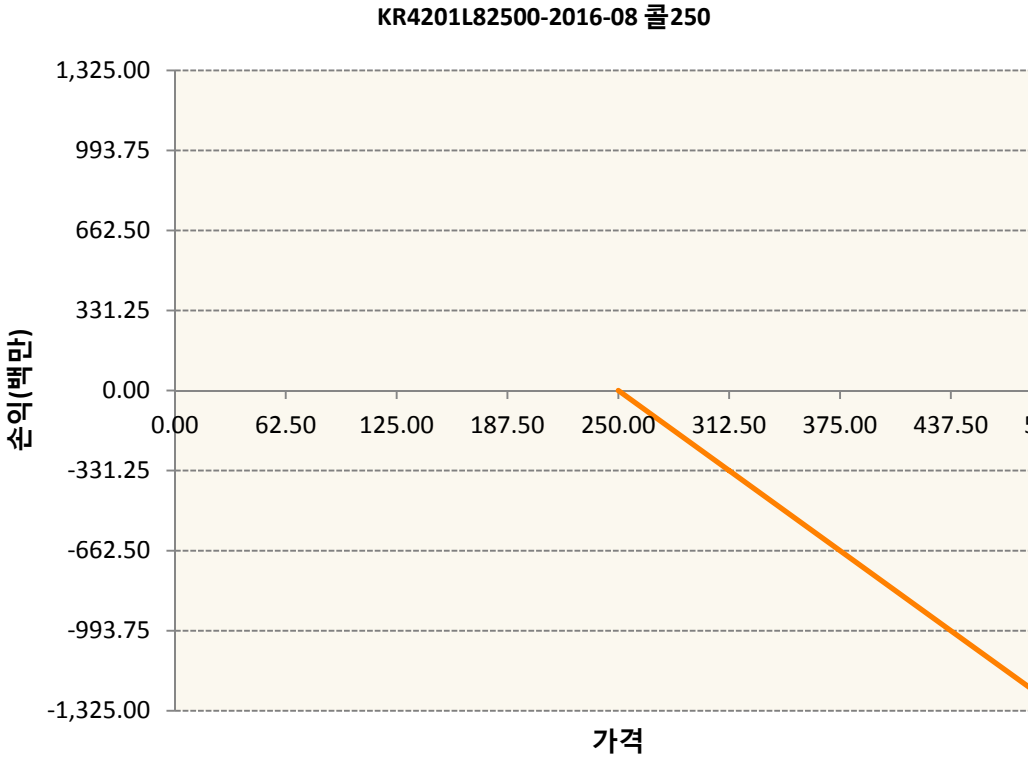
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,393	0	4,393	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,548	-1,548	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물						351
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351
-5.33%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	117	117	117	117	117	117	117
5.33%	234	234	234	234	234	234	234
8.00%	351	351	351	351	351	351	351
	KR4201L824 2016-08 콜247.5						82
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	24	23	23
-5.33%	23	23	23	22	21	21	20
-2.67%	19	18	16	15	14	13	12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-22	-23	-23	-24	-24	-25	-26
5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-53
8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
KR4201L825	2016-08 콜250						457

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	101	100	99
-5.33%	101	100	98	96	94	91	87
-2.67%	86	81	76	70	64	58	52
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-109	-113	-118	-123	-128	-133	-139
5.33%	-277	-278	-279	-281	-283	-286	-289
8.00%	-453	-454	-454	-454	-455	-456	-457

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

908

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

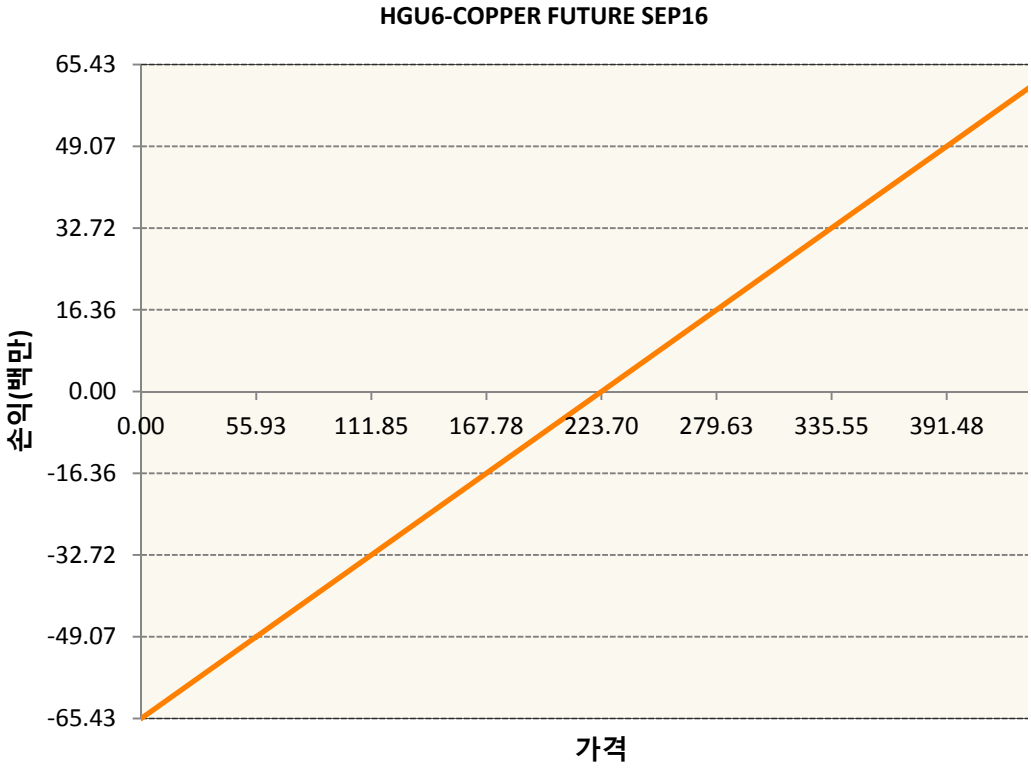
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

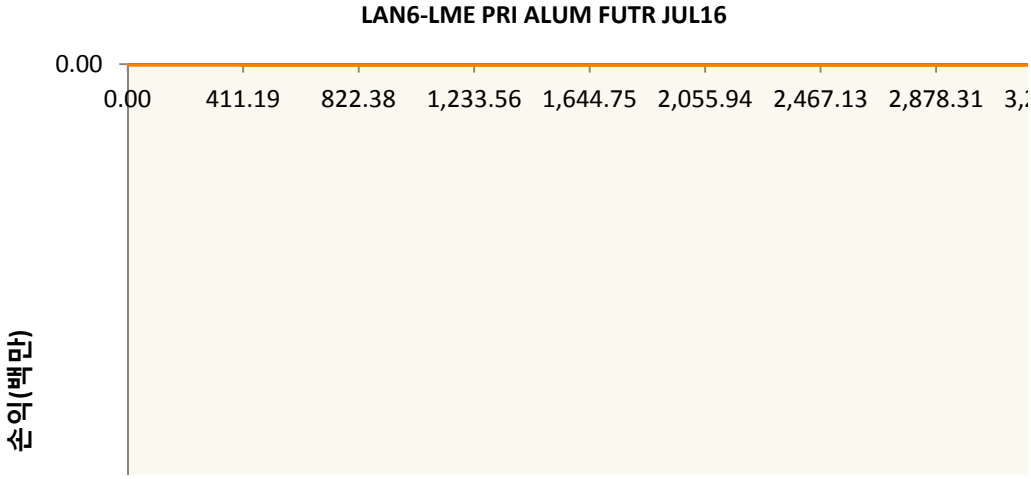
1. 계약금액

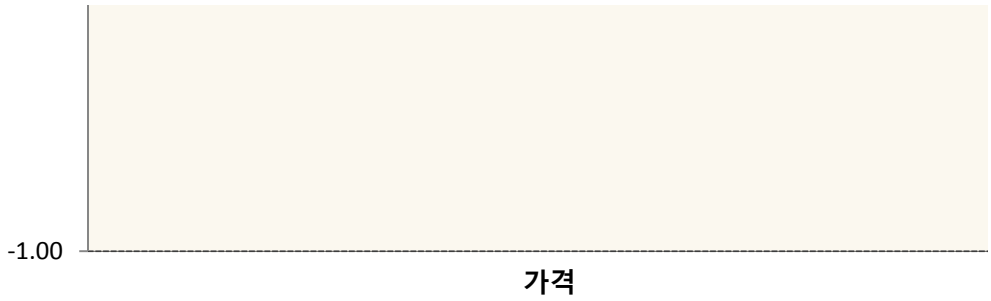
(단위:백만원)

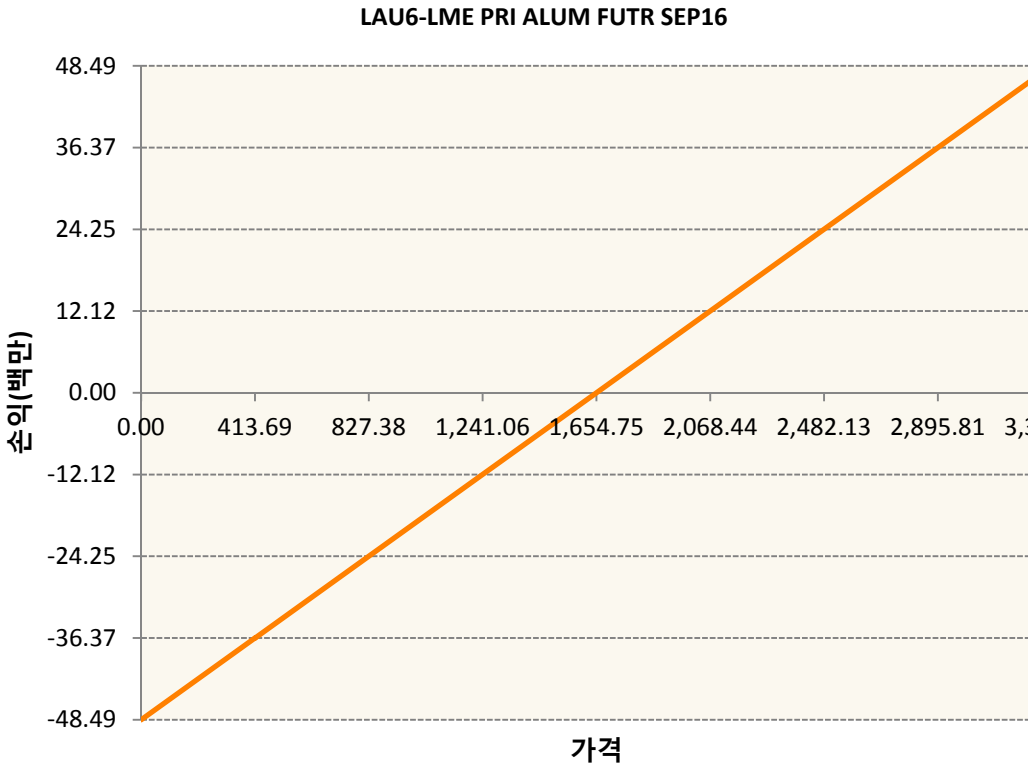
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	47	0	47	
누계	유가증권	선물	436	100	336	

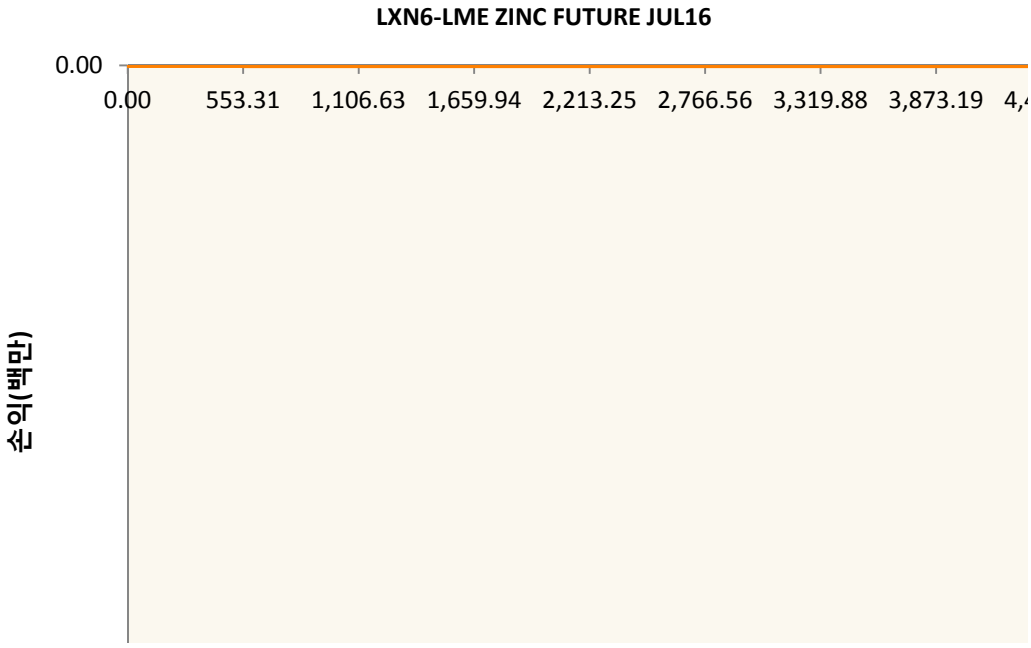
2. 만기시점의 손익구조

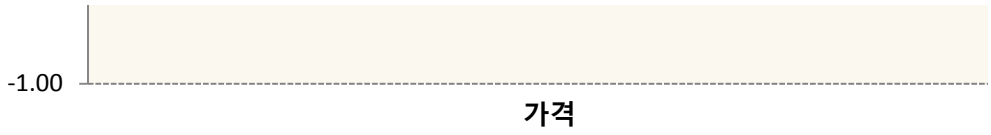


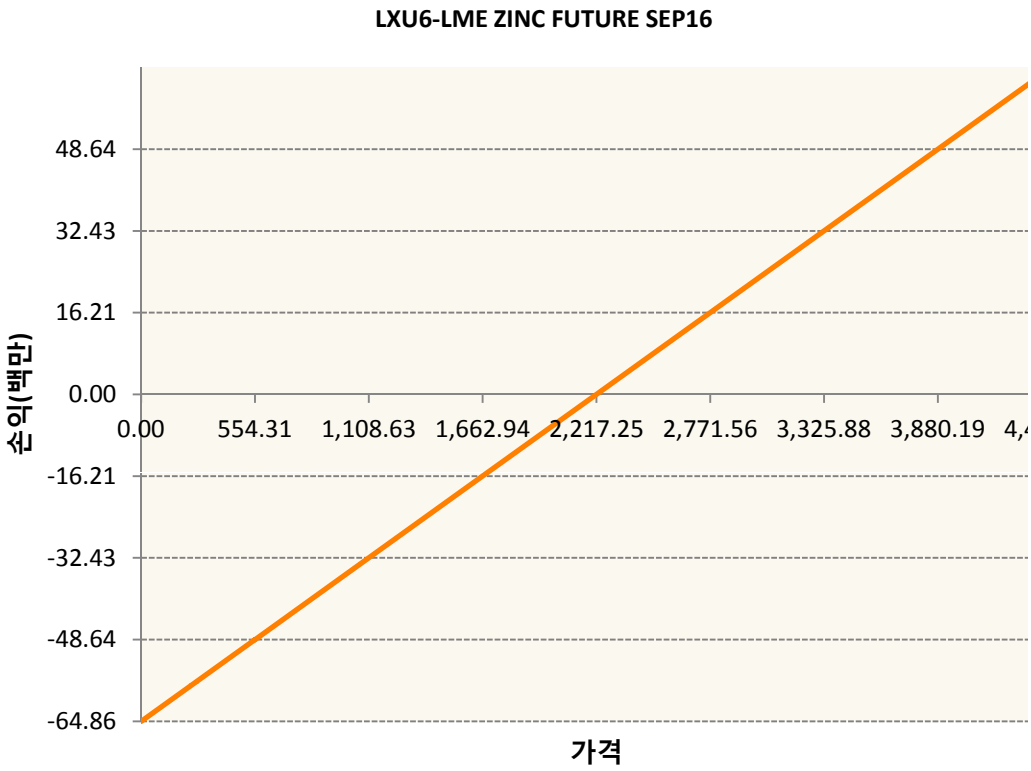


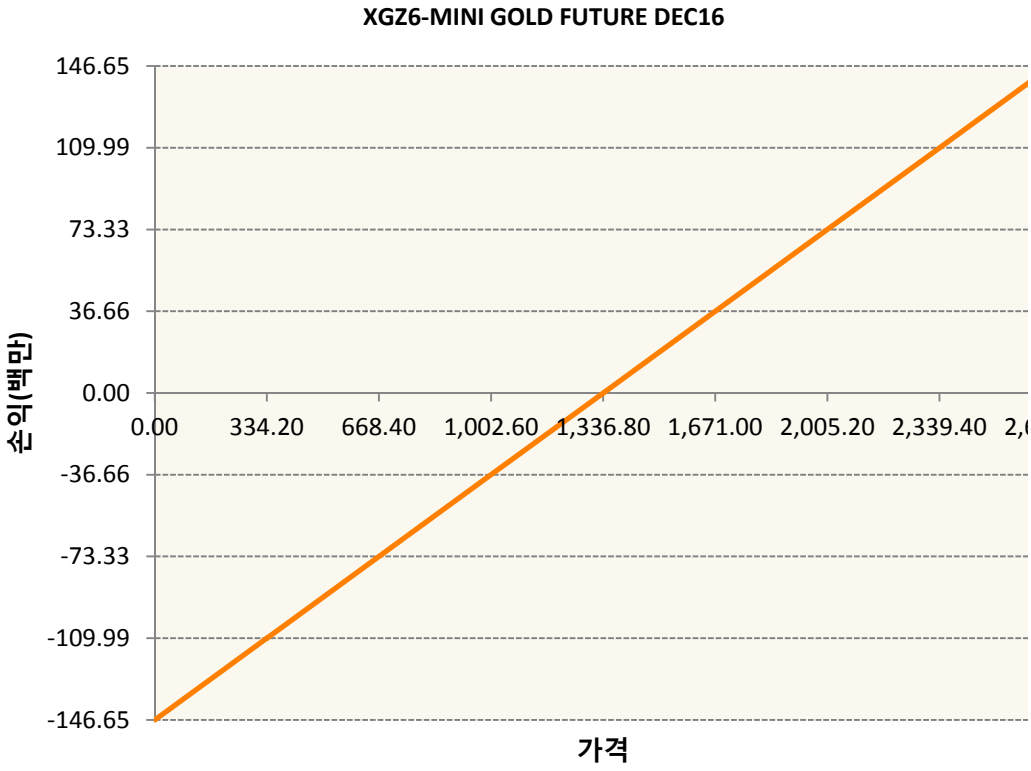

-1.00
가격

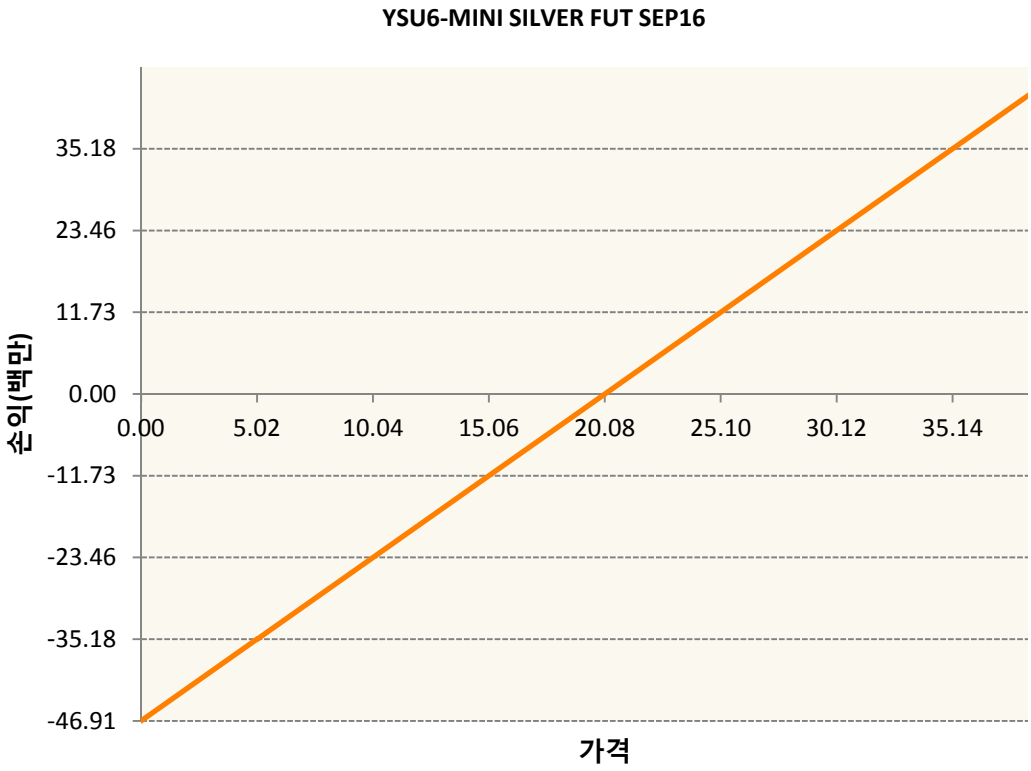

LAU6-LME PRI ALUM FUTR SEP16
48.49
36.37
24.25
12.12
0.00
-12.12
-24.25
-36.37
-48.49
0.00
413.69
827.38
1,241.06
1,654.75
2,068.44
2,482.13
2,895.81
순익(백만)
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
0.00
0.00
553.31
1,106.63
1,659.94
2,213.25
2,766.56
3,319.88
3,873.19
순익(백만)


-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
48.64
32.43
16.21
0.00
-16.21
-32.43
-48.64
-64.86
0.00
554.31
1,108.63
1,662.94
2,217.25
2,771.56
3,325.88
3,880.19
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
146.65
109.99
73.33
36.66
0.00
-36.66
-73.33
-109.99
-146.65
0.00
334.20
668.40
1,002.60
1,336.80
1,671.00
2,005.20
2,339.40
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HGU6	COPPER FUTURE SEP16	5
LAN6	LME PRI ALUM FUTR JUL16	0.1
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	4
LXN6	LME ZINC FUTURE JUL16	1
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	5
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	12
YSU6	MINI SILVER FUT SEP16	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

32

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

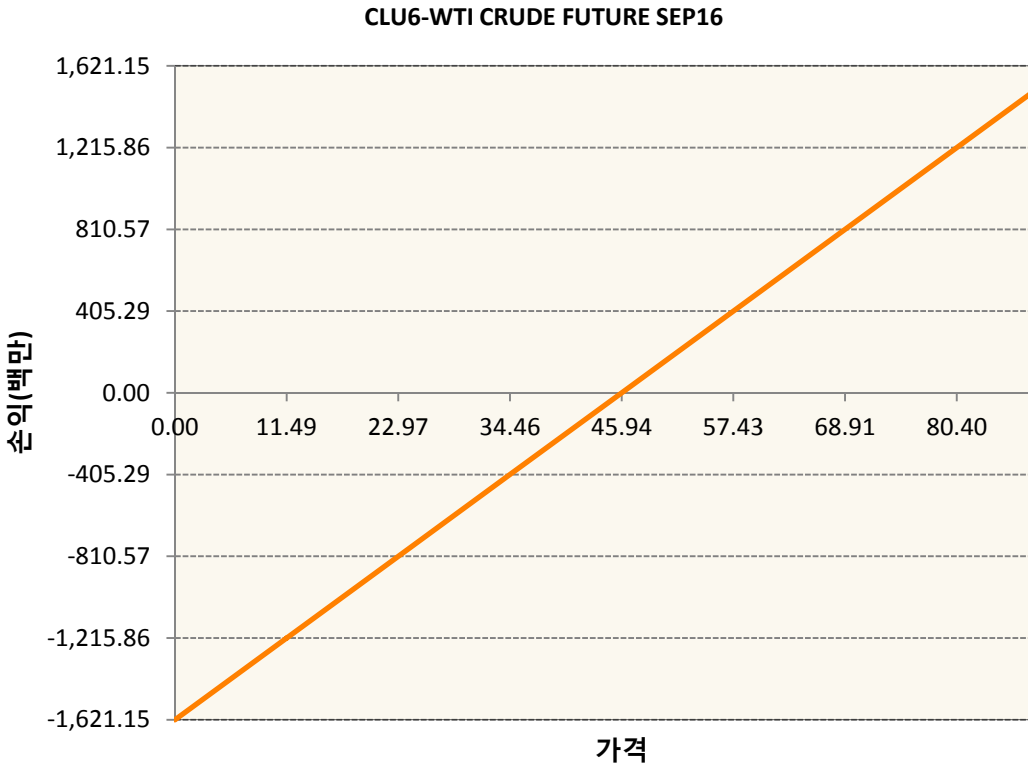
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

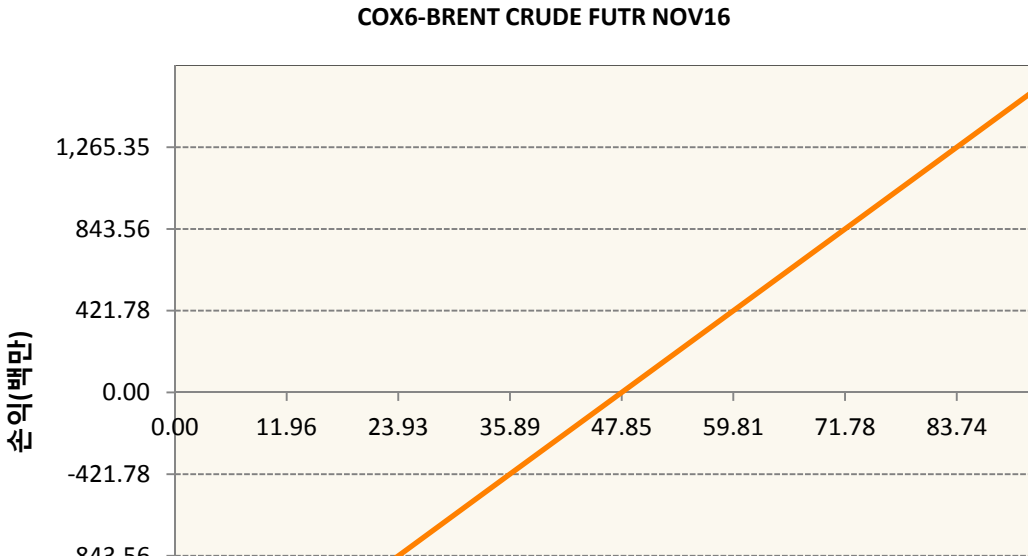
1. 계약금액

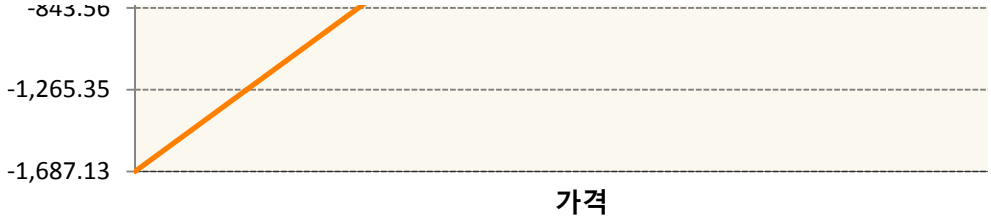
(단위:백만원)

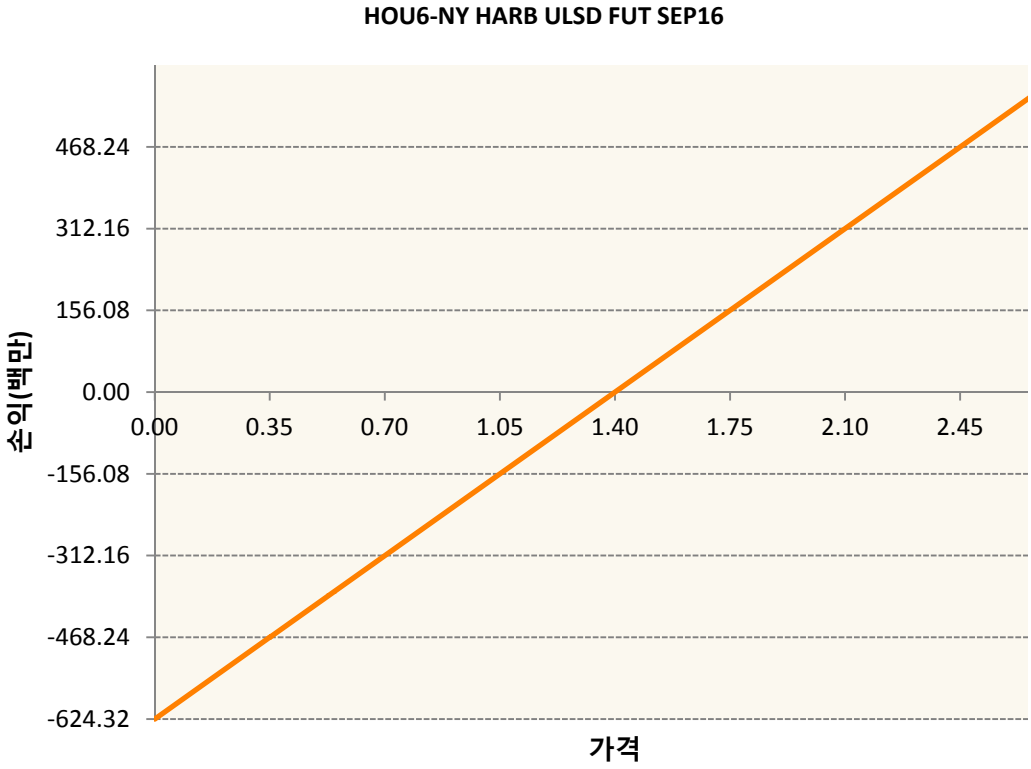
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,191	0	6,191	

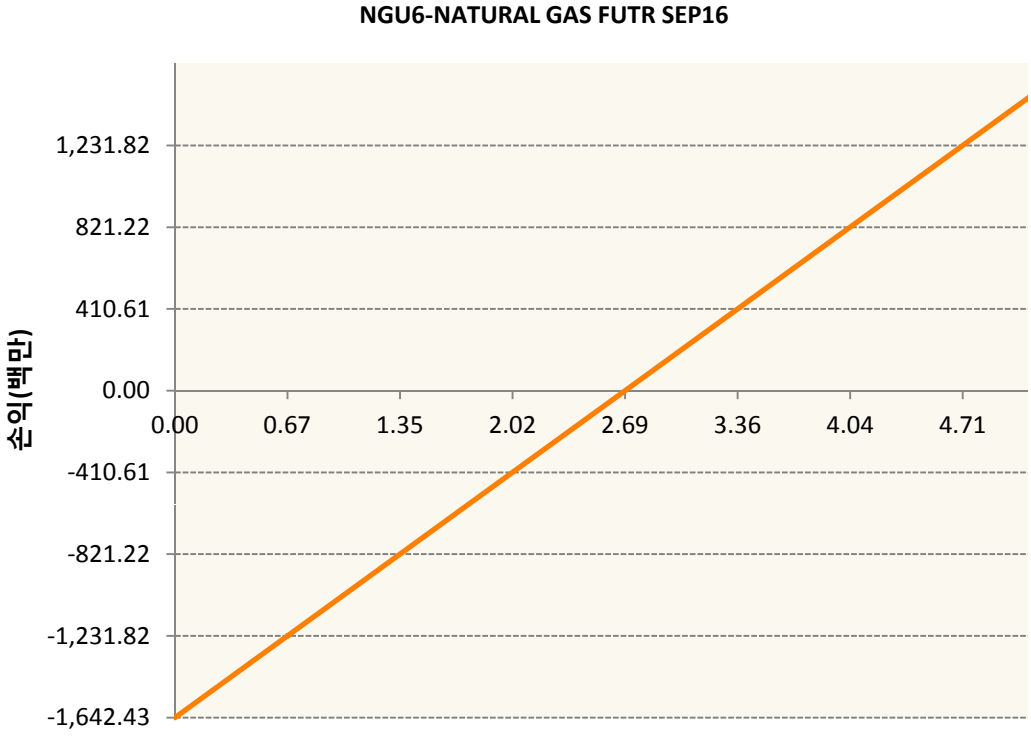
2. 만기시점의 손익구조



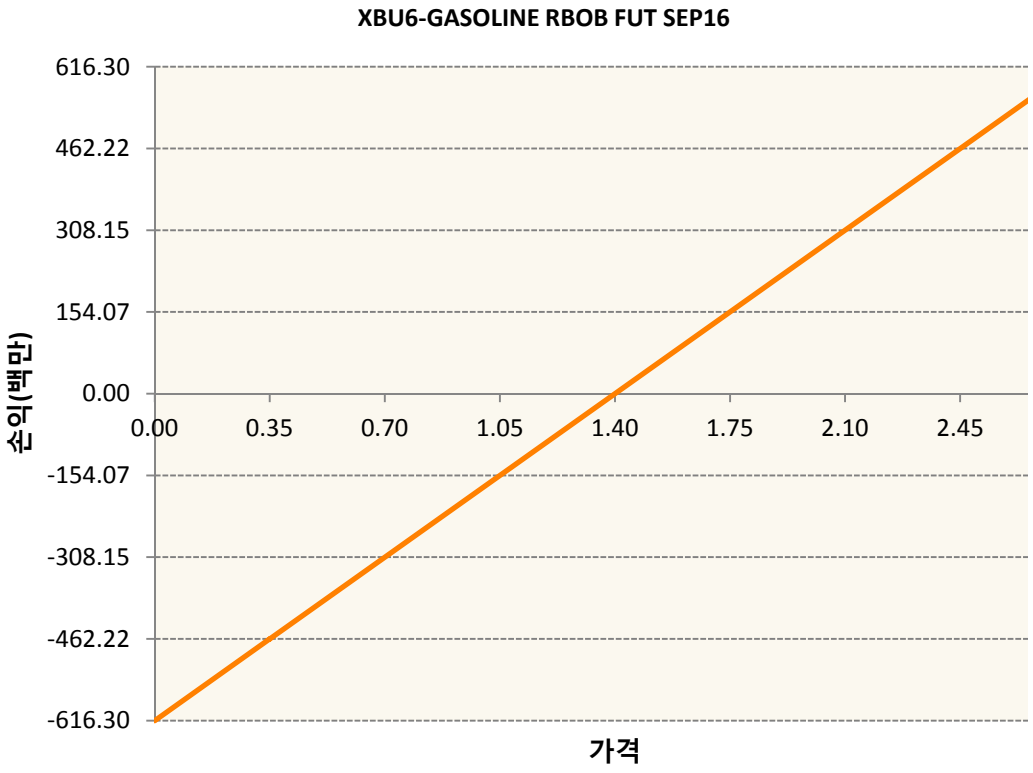



-1,265.35
-1,687.13
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
468.24
312.16
156.08
0.00
-156.08
-312.16
-468.24
-624.32
0.00
0.35
0.70
1.05
1.40
1.75
2.10
2.45
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,231.82
821.22
410.61
0.00
-410.61
-821.22
-1,231.82
-1,642.43
0.00
0.67
1.35
2.02
2.69
3.36
4.04
4.71
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	130
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	135
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	50
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	131
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,388

공시일	2016-07-20
기준일	2016-07-19

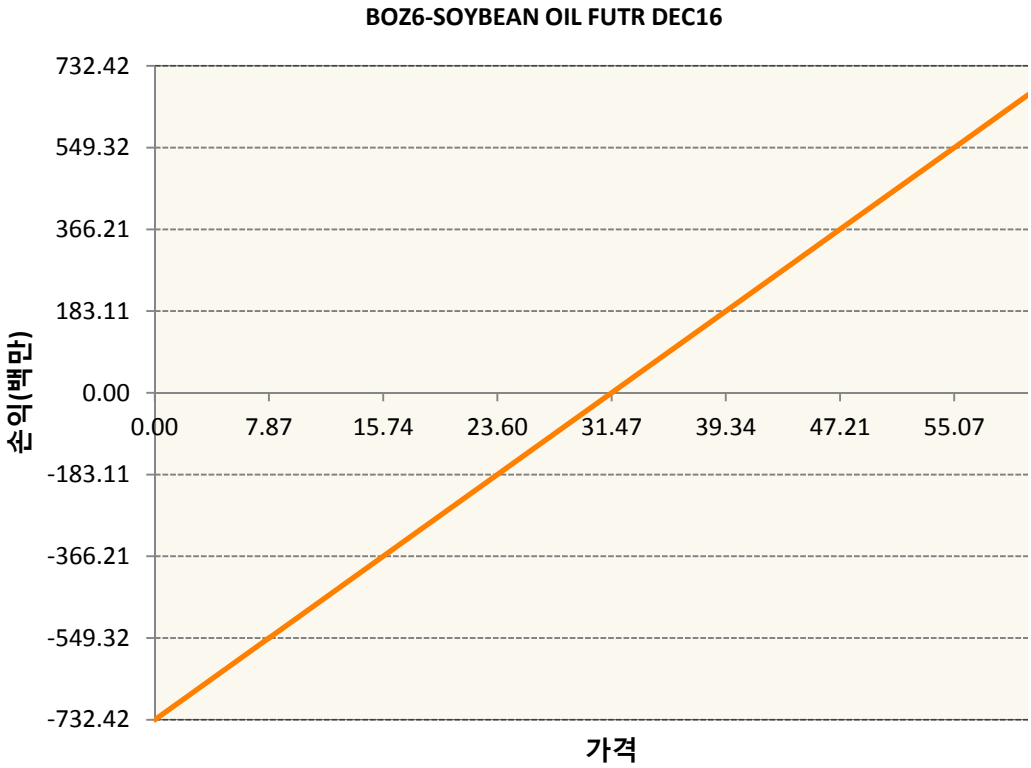
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

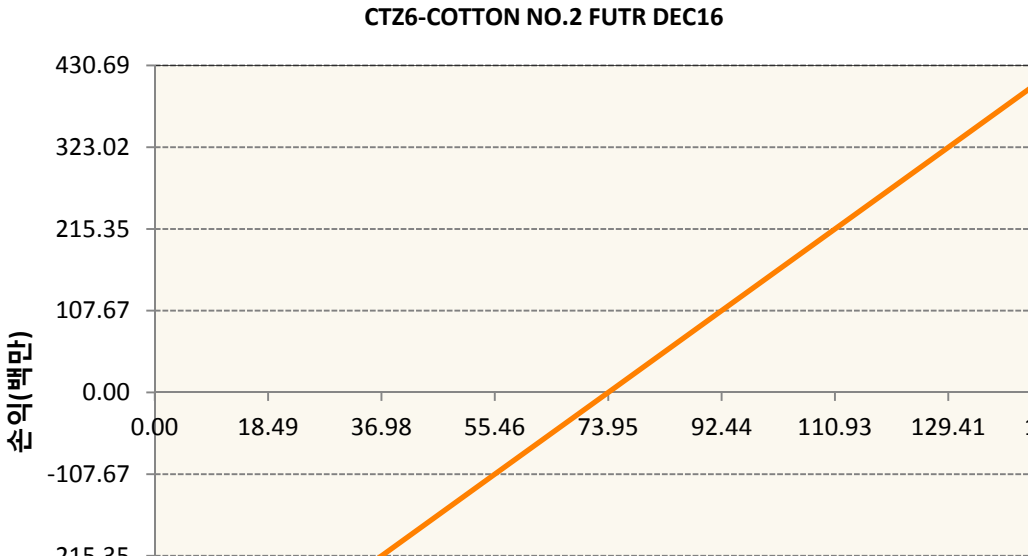
1. 계약금액

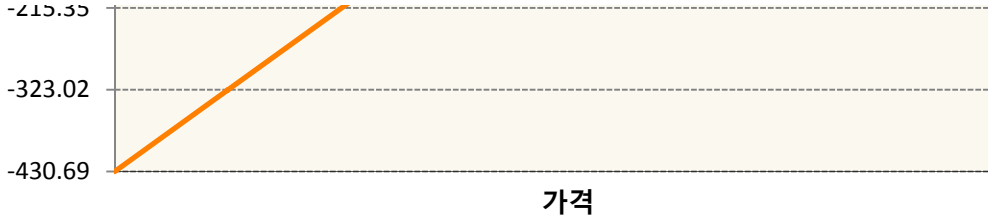
(단위:백만원)

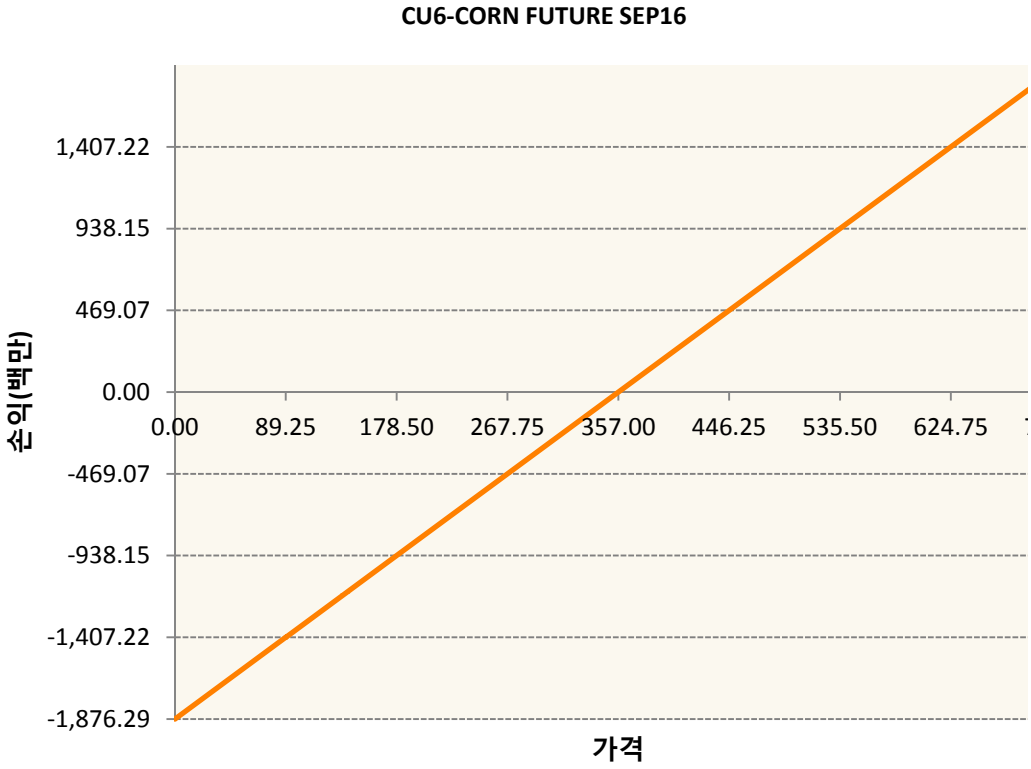
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,517	0	8,517	

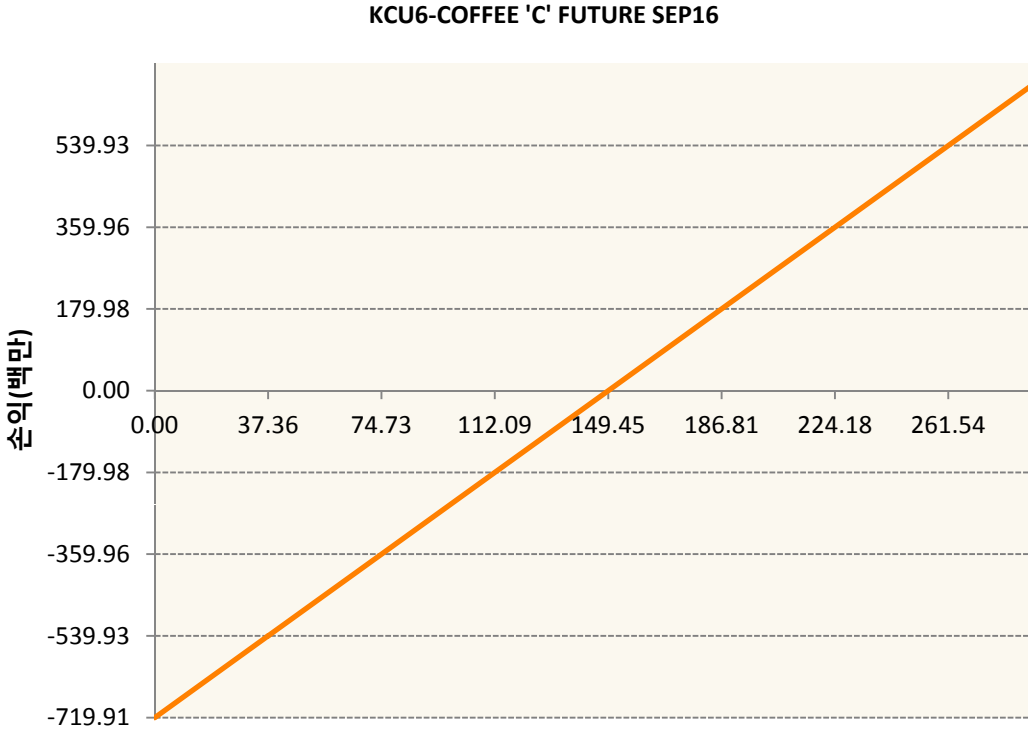
2. 만기시점의 손익구조



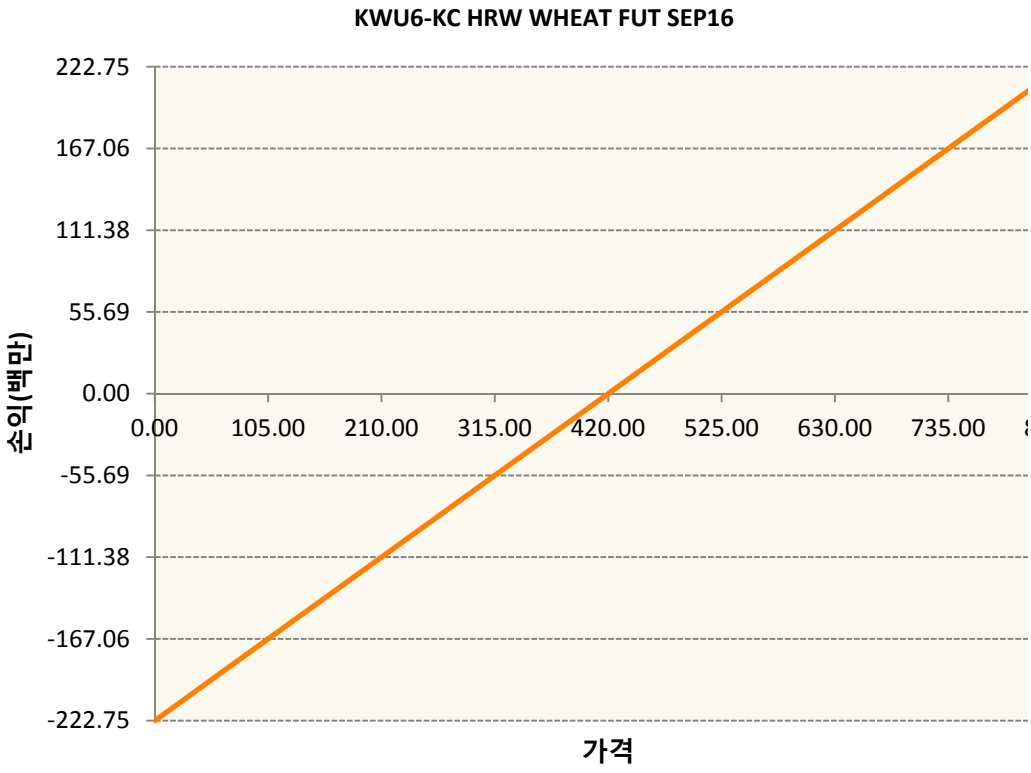


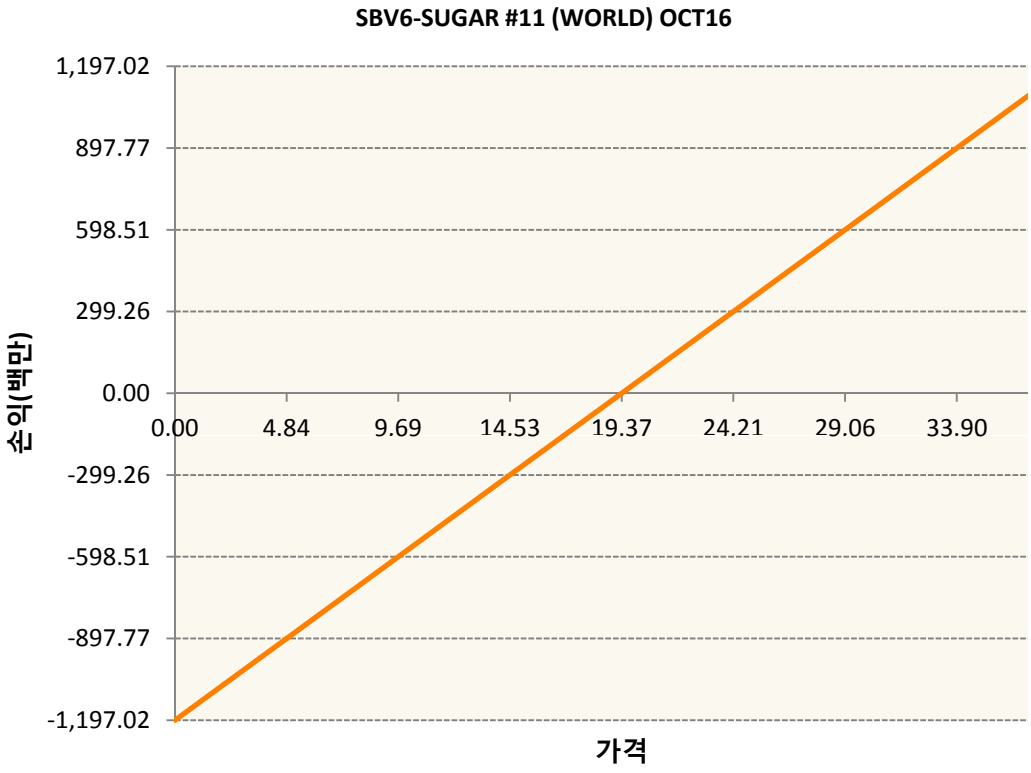

-323.02
-430.69
가격


CU6-CORN FUTURE SEP16
1,407.22
938.15
469.07
0.00
-469.07
-938.15
-1,407.22
-1,876.29
0.00
89.25
178.50
267.75
357.00
446.25
535.50
624.75
손익(백만)
가격

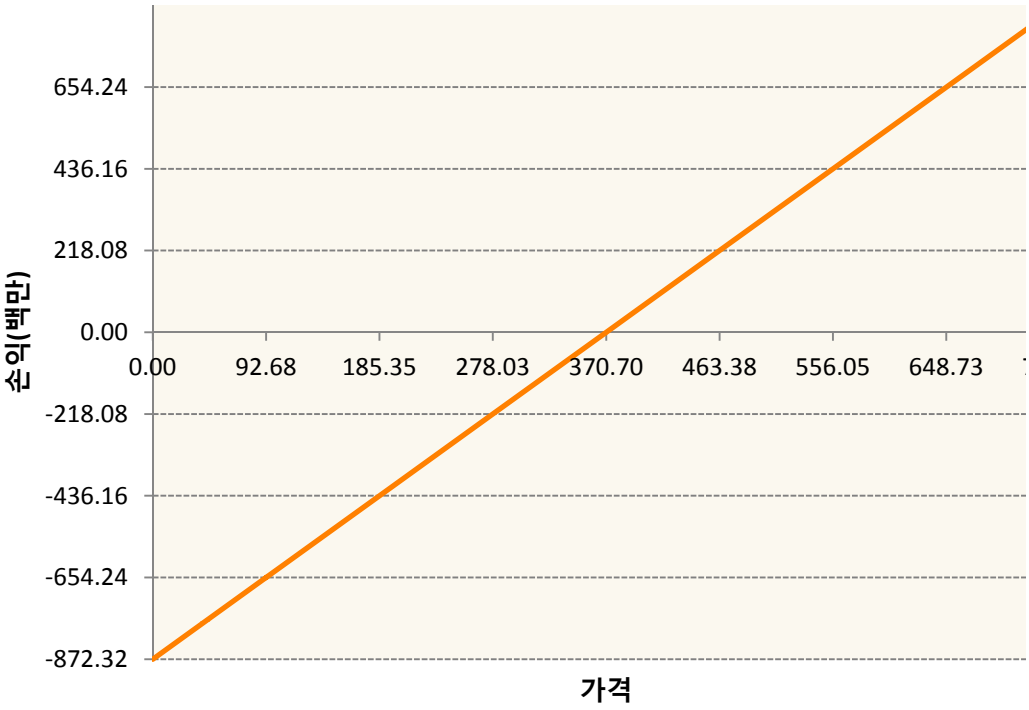

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
539.93
359.96
179.98
0.00
-179.98
-359.96
-539.93
-719.91
0.00
37.36
74.73
112.09
149.45
186.81
224.18
261.54
손익(백만)

가격

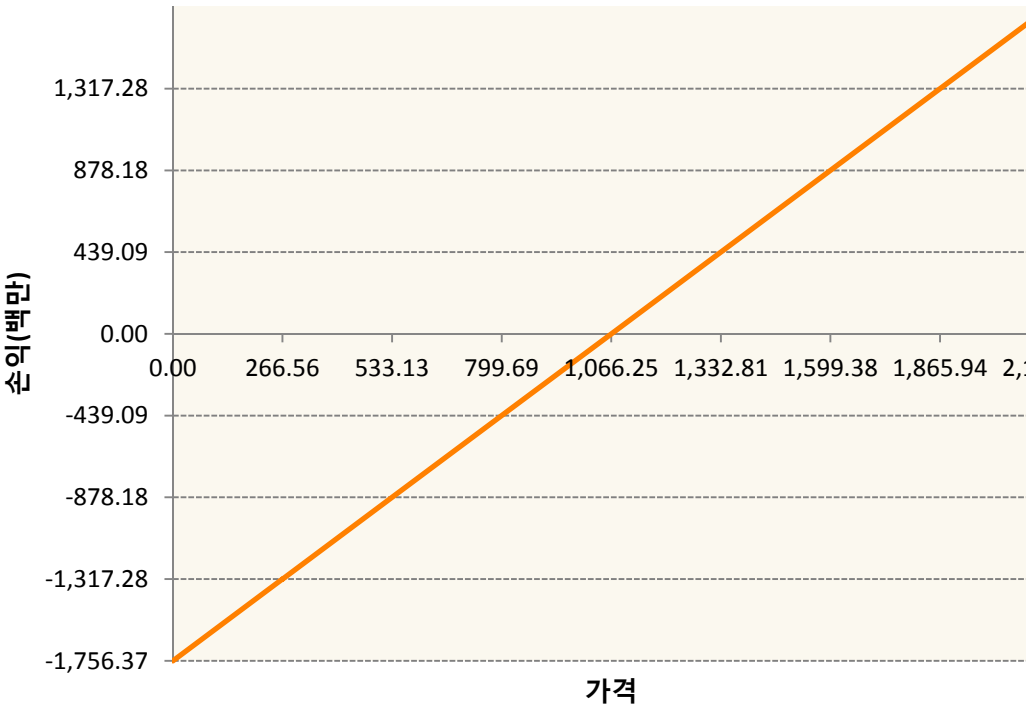

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
222.75
167.06
111.38
55.69
0.00
-55.69
-111.38
-167.06
-222.75
0.00
105.00
210.00
315.00
420.00
525.00
630.00
735.00
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,197.02
897.77
598.51
299.26
0.00
-299.26
-598.51
-897.77
-1,197.02
0.00
4.84
9.69
14.53
19.37
24.21
29.06
33.90
손익(백만)
가격

SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16

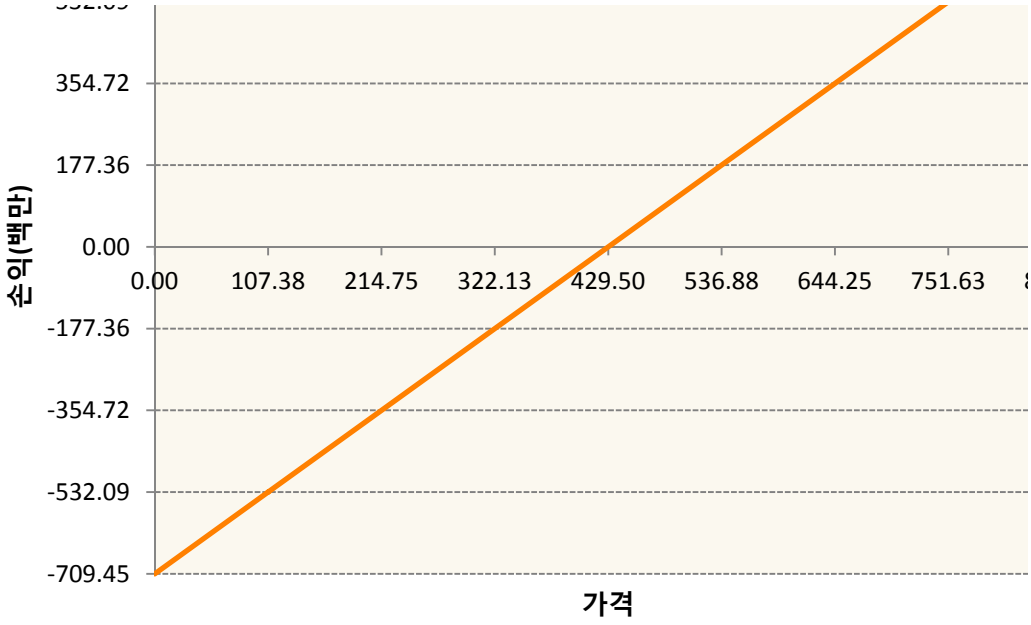


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16



WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	59
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	34
CU6	CORN FUTURE SEP16	150
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	58
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	96
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	70
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	141
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	968